

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 167号

2024年第2季度报告

重要信息提示：

- 理财非存款，产品有风险，投资须谨慎。理财产品过往业绩不代表其未来表现，不等于理财产品实际收益。
- 华夏理财有限责任公司保留对所有文字说明的最终解释权。

产品管理人：华夏理财有限责任公司

产品托管人：华夏银行股份有限公司

报 告 期：2024年4月1日至2024年6月30日

第一章 基本信息

| | |
|---------|--------------------------|
| 产品名称 | 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 167 号 |
| 理财产品代码 | 23121167 |
| 产品登记编码 | Z7003923000342 |
| 产品募集方式 | 公募 |
| 产品运作模式 | 封闭式 |
| 产品投资性质 | 固定收益类 |
| 投资及收益币种 | 人民币 |
| 产品风险评级 | PR2 级（中低风险） |
| 杠杆水平 | 105.27% |
| 产品起始日期 | 2023-09-01 |
| 产品终止日期 | 2024-10-08 |

第二章 净值、存续规模及收益表现

2.1 净值和存续规模

| 估值日期 | 份额净值 (元) | 份额总数(份) | 累计净值 (元) | 资产净值(元) |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|
| 2024-06-30 | 1.0343 | 1,208,526,411.00 | 1.0343 | 1,250,034,388.85 |

2.2 净值增长率

| | 起始和截止时间 | 净值增长率 |
|--------------|-----------------------|-------|
| 报告期间 | 2024年3月31日-2024年6月30日 | 1.09% |
| 成立以来 | 2023年9月1日-2024年6月30日 | 3.43% |
| 2023年 | 2023年9月1日-2023年12月31日 | 1.15% |

注：净值增长率=(期末累计净值-期初累计净值)/期初份额净值*100%；因投资者赎回可能导致在某个时期部分份额为0，该情形下净值增长率的所属区间不连续；年末份额为0时，该年度净值增长率为空；理财产品过往业绩不代表其未来表现，不等于理财产品实际收益，投资须谨慎。

第三章 资产持仓

3.1 期末产品资产持仓情况

| 序号 | 资产类别 | 穿透前占总资产比例 | 穿透后占总资产比例 |
|----|---------------|-----------|-----------|
| 1 | 现金及银行存款 | 0.52% | 12.34% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.07% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 1.09% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 42.89% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 43.20% | 41.08% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 0.00% |
| 7 | 金融衍生品 | 0.00% | 0.00% |
| 8 | 代客境外理财投资 QDII | 0.00% | 0.00% |
| 9 | 商品类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 10 | 另类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 11 | 公募基金 | 0.00% | 2.53% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 56.28% | 0.00% |
| 14 | 委外投资——协议方式 | 0.00% | 0.00% |

注：由于计算中四舍五入的原因，占总资产的比例可能存在尾差；“权益类投资”类别中包含优先股。

3.2 期末产品持有的前十项资产

| 序号 | 资产名称 | 资产类别 | 持有金额 (元) | 占总资产 的比例 |
|----|---|-----------------|----------------|-------------|
| 1 | 渤海信托.绍兴市柯桥区中心.债权 168号.债权167号 | 非标准化债权类 资产 | 260,238,995.03 | 19.78% |
| 2 | 山东信托.洛阳国晟.融华16号.债权 封闭171号.167号.157号 | 非标准化债权类 资产 | 150,209,728.79 | 11.41% |
| 3 | 渤海信托.浙江金华金义新区发展集 团有限公司.2023盈夏3号.债权167 号.158号.186号 | 非标准化债权类 资产 | 70,045,475.44 | 5.32% |
| 4 | 中信信托.成都空港现代服务业发展 有限公司.华信8号.第4期.债权封闭 167号 | 非标准化债权类 资产 | 60,067,882.02 | 4.56% |
| 5 | 建设银行溧阳嘉丰支行 20231215-35 | 现金及银行存款 | 36,733,013.09 | 2.79% |
| 6 | 21住开02 | 债券 | 15,931,634.53 | 1.21% |
| 7 | 建设银行盱眙支行 20231213-15 | 现金及银行存款 | 15,745,675.12 | 1.20% |
| 8 | 建设银行南京城中支行 20231213-15 | 现金及银行存款 | 15,745,675.12 | 1.20% |
| 9 | 建设银行南京溧水支行 20231214-15 | 现金及银行存款 | 15,744,197.51 | 1.20% |
| 10 | 债券买入返售 | 拆放同业及债券 买入返售 | 14,311,054.87 | 1.09% |

3.3 期末产品持有的非标准化债权类资产

| 序号 | 融资客户 | 项目名称 | 交易结构 | 收益率 (%) | 剩余期限 (天) | 风险状况 |
|----|---------------------|--|------|---------|----------|------|
| 1 | 绍兴市柯桥区中心城建设投资开发有限公司 | 渤海信托.绍兴市柯桥区中心.债权 168 号.债权 167 号 | 信托贷款 | 4.5380 | 100 | 正常 |
| 2 | 洛阳国晟投资控股集团有限公司 | 山东信托.洛阳国晟.融华 16 号.债权封闭 171 号.167 号.157 号 | 信托贷款 | 5.0576 | 100 | 正常 |
| 3 | 浙江金华金义新区发展集团有限公司 | 渤海信托.浙江金华金义新区发展集团有限公司.2023 盈夏 3 号.债权 167 号.158 号.186 号 | 信托贷款 | 4.4360 | 100 | 正常 |
| 4 | 成都空港现代服务业发展有限公司 | 中信信托.成都空港现代服务业发展有限公司.华信 8 号.第 4 期.债权封闭 167 号 | 信托贷款 | 4.8200 | 100 | 正常 |

3.4 报告期内关联交易情况

3.4.1 报告期内投资关联方发行的证券的情况

| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 投资规模（元） |
|------------|--------------|--------------------|------------|
| 兴业银行股份有限公司 | 232480020 | 24 兴业银行二级资本债 01 | 238,891.47 |
| 兴业银行股份有限公司 | 242480002 | 24 兴业银行永续债 01 | 92,319.35 |
| 兴业银行股份有限公司 | 242480002.IB | 24 兴业银行永续债 01 | 133,280.47 |

3.4.2 报告期内投资关联方承销的证券的情况

| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 投资规模（元） |
|-------|------|------|---------|
| - | - | - | - |

3.4.3 报告期内其他关联交易

| 关联方名称 | 资产代码 | 资产名称 | 交易类型 | 投资规模（元） |
|----------------|----------------------------------|--------------------------|------|--------------|
| 中诚信托有 限责任公司 | ZXD32Z2024 01010032472 OTC | 中诚信托-汇鑫 30 号 集合资金信托计划 | 买入 | 2,000,000.00 |

第四章 收益分配情况

| 除权日期 | 每万份理财份额分红数（元） |
|------|---------------|
| - | - |

第五章 风险分析

5.1 投资组合流动性风险分析

本产品报告期内未开放，持有一定的高流动性资产，可以满足临时赎回的需求，流动性风险可控。

5.2 投资组合投资风险分析

5.2.1 产品债券持仓风险及价格波动情况

本产品持有中高信用等级信用债及精选债券基金，本报告期内估值在正常范围波动。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

无。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无。

第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号 |
|----|------|------------------|
| 1 | 托管账户 | 1025700000943984 |

第七章 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。